

2010下半年证券从业资格《投资分析》考试大纲 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/647/2021_2022_2010_E4_B8_8B_E5_8D_8A_c33_647388.htm 2010年证券从业资格全科套餐

，七折优惠，并赠送100元模考卡！第四部分 证券投资分析目的与要求 本部分内容包括股票、债券、证券投资基金、可转换债券以及权证等的投资价值分析.宏观经济分析的基本指标，宏观经济运行、经济政策以及国际金融市场环境等与证券市场之间的关系.股票市场的供求决定因素以及变动特点.行业的一般特征、影响行业兴衰的主要因素以及行业的定性和定量分析方法.公司的基本特征分析、财务分析以及其他主要因素的分析.证券投资技术分析的主要理论以及主要技术指标.证券组合理论、资本定价模型以及证券组合的业绩评估等.金融工程的技术应用、期货(包括股指期货)的套期保值与套利以及风险管理VAR方法等。通过本部分的学习，要求熟练掌握证券投资的价值分析、宏观经济分析、行业分析、公司分析、技术分析、证券投资组合的基础理论和应用方法以及金融工程与期货的理论与应用。第一章 证券投资分析概述 掌握证券投资的含义及证券投资分析的目标。熟悉证券投资分析理论发展史。熟悉证券投资分析的基本要素.熟悉我国证券市场现存的主要投资方法、理念及策略.掌握基本分析法、技术分析法、证券组合分析法的定义、理论基础和内容.熟悉证券投资分析应注意的问题。掌握证券投资分析的信息来源。第二章 有价证券的投资价值分析与估值方法 熟悉证券估值的含义.熟悉虚拟资本及其价格运动形式.掌握有价证券的市场价格、内在价值、公允价值和安全边际的含义及相互关系.熟悉货

币的时间价值、复利、现值和贴现的含义及其例证.掌握现金流贴现和净现值的计算.掌握绝对估值和相对估值方法并熟悉其模型常用指标和适用性.熟悉资产价值.熟悉衍生产品常用估值方法。掌握债券估值的原理.掌握债券现金流的确定因素.掌握债券贴现率概念及其计算公式.熟悉债券报价.掌握不同类别债券累计利息的惯例计算和实际支付价格的计算.熟悉债券估值模型.掌握零息债券、付息债券、累息债券的订价计算.掌握债券当期收益率、到期收益率、即期利率、持有期收益率、赎回收益率的计算.熟悉利率的风险结构、收益率差、信用利差等概念.熟悉利率的期限结构.掌握收益率曲线的概念及其基本类型.熟悉期限结构的影响因素及利率期限结构基本理论。熟悉影响股票投资价值的内外部因素及其影响机制.熟悉计算股票内在价值的不同股息增长率下的现金流贴现模型.掌握计算股票内在价值的不同股息增长率下的现金流贴现模型公式及应用.熟悉计算股票市场价格的市盈率估价方法及其应用缺陷.熟悉市净率的基本概念及其在股票估值方面的运用。熟悉金融期货合约的定义及其标的.掌握金融期货理论价格的计算公式和影响因素。熟悉金融期权的定义.掌握期权的内在价值、时间价值及期权价格影响因素。掌握可转换证券的定义.熟悉可转换证券的投资价值、转换价值、理论价值和市场价值的含义及计算方法.掌握可转换证券转换平价、转换升水、转换贴水的计算.熟悉可转换证券转换升水比率、转换贴水比率的计算。掌握权证的概念及分类.熟悉权证的理论价值的含义、各变量变动对权证价值的影响以及权证理论价值的计算方法.掌握认股权证溢价计算公式.熟悉认股权证的杠杆作用。

第三章 宏观经济分析 熟悉宏观经济分析的意义.熟悉总量分

析和结构分析的定义、特点和关系.熟悉宏观分析资料的搜集与处理方法。熟悉国民经济总体指标、投资指标、消费指标、金融指标、财政指标的主要内容，熟悉各项指标变动对宏观经济的影响。掌握国内生产总值的概念及计算方法，熟悉国内生产总值与国民生产总值的区别与联系.掌握失业率与通货膨胀的概念，熟悉失业率与通货膨胀率的衡量方式.掌握零售物价指数、生产者价格指数、国民生产总值物价平减指数的概念.熟悉国际收支、社会消费品零售总额、城乡居民储蓄存款余额、居民可支配收入等指标的内容.掌握货币供应量的三个层次.熟悉金融机构各项存贷款余额、金融资产总量的含义和构成.熟悉外汇储备及外汇储备变动情况.掌握利率及基准利率的概念.熟悉再贴现率、熟悉同业拆借利率、回购利率和各项存贷款利率的变动影响.熟悉汇率的概念及汇率变动的影响.熟悉财政收支内容以及财政赤字或结余的概念。掌握证券市场与宏观经济运行之间的关系.熟悉中国股市表现与GDP、经济周期、通货变动对证券市场的影响.熟悉我国证券市场指数走势与我国GDP增长趋势的实际关系。掌握财政政策和主要财政政策手段.熟悉积极财政政策及紧缩财政政策对证券市场的影响掌握货币政策和货币政策工具.熟悉货币政策的调控作用以及货币政策对证券市场的影响.掌握收入政策含义.熟悉收入政策的目标及其传导机制.熟悉我国收入政策的变化及其对证券市场的影响.熟悉国际金融市场环境对我国证券市场的影响途径。熟悉证券市场供求关系的决定原理.熟悉我国证券市场供需方的发展及现状.掌握影响证券市场供给和需求的因素以及影响我国证券市场供求关系的基本制度变革。 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问

